

**<<資金需給>>**

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 400	▲ 1,000
財政		▲ 19,600	▲ 800	▲ 13,000
資金過不足		▲ 19,600	▲ 1,200	▲ 14,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		4,700		
66,829		▲ 12,700		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入		20,000		
国庫短期証売却				
国債買入			12,000	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入			1,000	
ETF買入			200	
国債補完供給	即日	▲ 200		
		400	200	
小計		12,000	13,200	0
当増増減		▲ 7,600	12,000	▲ 14,000

当座預金残高	1,830,900	2/17以降の残り所要積立額	748,000
準備預金残高	1,662,500	2/18以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,259,400	積数	271,800
超過準備	888,000	1日平均	10,500
非準預先残高	168,400	積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,776,900
準備預金進捗率	84.70% (実績)		7.14% (日数)

2/16のマナターベース		2,768,400	
2/16コール	合計	206,931	無担 80,918 有担 126,013
コール前日増減	計	6,675	無担 1,962 有担 4,713

2/17の加重平均レート(速報)				2/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.060 ~0.128 (0.079)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.130 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.071 ~0.125 (0.082)				T/N		0.073 ~0.125 (0.099)	
0.110 (0.110)				S/N		0.100 ~0.125 (0.101)	
				1W		0.090 (0.090)	
0.200 ~0.310 (0.218)				2W			
				3W			
				1M	0.170 (0.170)		有担先日付分
				2M			
				3M			
				6M			
				1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	2,000億円	2/17 ~ 2/18 (1日間)	応札 7億円	落札 7億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債補完	1,009億円	2/17 ~ 2/18 (1日間)	応札 122億円	落札 122億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
CP買入	4,000億円	2/20	応札 11,584億円	落札 3,995億円	按分レート 0.092%	82.5%	平均落札レート 0.094%
T-Bill1Y	応札16兆8,179億円	落札2兆3,175億5,000万円(非競争入札:1,824億円)	2/19~2016/2/22	0.0000%	按分14.8406%	平均▲0.0009%	
20年利付国債(表面利率1.2%)	応札3兆8,746億円	落札1兆1,038億円(I非競争入札:957億円)	2/19~2034/12/20	1.275%	按分74.6538%	平均1.274%	

<< 2/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,842,900	前日比	12,000
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

試し取りにより、加重平均は高めとなるのが予想されるが、出合いの中心は0.07%前半半となると見込まれる。

**<< 17日のインターバンク市場動向 >>**  
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、136兆4,000億円(当座預金残高見込みは183兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、大手行からは0.068%での調達希望で始まった。出合いの中心は0.072%と昨日と同水準の立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、0.07%前半半での出合いが散見される程度で取引を終えた。また、昨日に続き一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が上昇した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

**<< 17日のオープン市場動向 >>**  
 現先S/N物は前日比横ばいで推移した。短国市場では1Y物(513回)入札が実施された。入札結果は平均落札レート▲0.0009% 按分落札レート±0%となった。セカンダリーは、事前予想通りの結果となったことから▲0.005~▲0.002%と小動きであった。CP市場は、償還総額1,000億円程度に対し発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏での動き。CP等買入オペが実施され、平均落札利回り0.094% 按分落札利回り0.092% 按分率82.5%と、足元のレートの高さを反映した結果となった。

**<< 18日の材料 >>**  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀総裁、定例会見  
 \*米国1月の米生産者物価指数 \*米国1月の住宅着工件数  
 \*米国1月の鉱工業生産・設備稼働率

<<コール1月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07394%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07450%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.390	▲0.060	日経平均株価(終値)	17,987.09	▲17.68	為替(9時)	118.48-50
						為替(5時)	118.53-54

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	2/9	2/10	2/12	2/13	2/16	2/17
日銀当預残	1,772,600	1,778,700	1,800,300	1,864,100	1,838,500	1,830,900
準備預金残	1,613,700	1,617,600	1,635,600	1,687,100	1,671,100	1,662,500
レート	0.081%	0.074%	0.074%	0.073%	0.075%	0.079%
月平均	0.07400%	0.07400%	0.07400%	0.07380%	0.07388%	0.07418%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入